（上接B167版）

十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基金投资组合应符合以下规定：		新增： （4）本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%。其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。 本基金投资投资于主体信用评级低于AAA的商业银行的银行存款为货币市场类产品，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。 （5）本基投资组合中的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%；除第（15）、（16）项外，现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过30%；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。	（5）投资于具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的20%；投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的5%；本基金管理人管理的全部投资于商业银行的银行存款、大额存单的资产，不得超过基金资产净值的30%；在投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的存款、大额存单的资产的比例，不得超过基金资产净值的30%，但投资于有存款期限、根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；
十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基金投资组合应符合以下规定：	（4）本基金投资于银行存款、清算备付金、贵金属、现金类资产、债券回购、银行间同业拆借、期货交易保证金、应收利息、应收申购款等流动性资产的比例合计不得低于5%。前述现金类资产和债券回购的期限均在1个交易日内可赎回的品种。 （5）本基投资组合中的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%；除第（15）、（16）项外，现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过30%；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。	（6）投资于具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的20%；投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的银行存款、同业存单，合计不得超过基金资产净值的5%；本基金管理人管理的全部投资于商业银行的银行存款、大额存单的资产，不得超过基金资产净值的30%；在投资于不具有基金托管资格的同一商业银行的存款、大额存单的资产的比例，不得超过基金资产净值的30%，但投资于有存款期限、根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；
十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基金投资组合应符合以下规定：	（6）除发生日期顺延、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回50%以上的情形外，本基金的投资组合中，债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%。 因发生日期顺延或依供货市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%，基金管理人应当在5个交易日内进行调整。 （7）本基金不得投资于可转换债券； （8）本基金投资持有的剩余期限不超过债券的债券余额不得超过基金资产净值的20%； （9）本基金投资持有的剩余期限不超过1年的中央银行票据的债券成本总计不得超过当日基金资产净值的20%。 （10）本基金不得投资于可以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外。	（7）基金管理人管理的全部投资于市场类产品投资于商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末资产的10%；
十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基金投资组合应符合以下规定：	（6）除发生日期顺延、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回50%以上的情形外，本基金的投资组合中，债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%。 因发生日期顺延或依供货市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%，基金管理人应当在5个交易日内进行调整。 （7）本基金不得投资于可转换债券； （8）本基投资持有的剩余期限不超过债券的债券余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%。 （9）本基投资持有的剩余期限不超过1年的中央银行票据的债券成本总计不得超过当日基金资产净值的20%。	（8）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的百分之五，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； …… （9）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的百分之五，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基金投资组合应符合以下规定：	（14）本基金不得投资于信用等级在AA+以下的债券与非金融企业债券融资工具； （15）当本基金剩10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%；基金管理人对本基金前10名份额持有人的持有份额比例进行跟踪时，可不将其固有资金投资的基金份额纳入跟踪范围； （16）当本基金剩10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；基金管理人对本基金前10名份额持有人的持有份额比例进行跟踪时，可不将其固有资金投资的基金份额纳入跟踪范围； （17）本基金投资投资于货币市场基金的比例合计不得超过本基金资产净值的10%；投资于开放式基金的比例合计不得超过30%；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。	（15）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 （16）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。 （17）本基金管理人管理的全部开放式基金合计持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%，完全按照指数编制方案进行复制的指数型基金除外；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%，但投资于有存款期限、根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制。
十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基金投资组合应符合以下规定：	（16）本基金在基金合同生效后三个月内使基金投资组合符合基金合同的有关约定。除上述第（1）项、第（6）项第1款、第（7）项、第（8）项及法律法规另有约定外，因基金规模或市场变化等基金管理人之外的原因导致投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在10个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。 （17）本基金投资于证券市场基金的比例合计不得超过本基金资产净值的20%。 （18）对及法律法规另有约定外，因基金规模或市场变化等基金管理人之外的原因导致投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在10个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。	（16）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 （17）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。 （18）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。
十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基金投资组合应符合以下规定：	4. 本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%。其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。 本基金投资于主体信用评级低于AAA的商业银行的银行存款为货币市场类产品，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。 （5）本基投资组合中的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%；除第（15）、（16）项外，现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。	（17）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。 （18）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。
十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基金投资组合应符合以下规定：	6. 本基投资于主体信用评级低于AAA的商业银行的银行存款为货币市场类产品，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。 （7）本基投资投资于货币市场基金的比例合计不得超过本基金资产净值的20%。 （8）本基投资投资于开放式基金的比例合计不得超过本基金资产净值的30%。 （9）本基投资投资于主体信用评级低于AAA的商业银行的银行存款为投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在10个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。	（19）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的百分之五，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 …… （20）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。 …… （21）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基投资组合应符合以下规定：	2. 投资组合平均剩余期限与平均剩余存续期限计算公式 （1）投资组合平均剩余期限与平均剩余存续期限计算公式 投资组合平均剩余存续期限＝∑投资组合现金资产净值×剩余存续期／投资组合资产净值。现金资产，国债、中央银行票据、政策性金融债券、银行存款、同业存单、大额存单、债券、逆回购、银行间拆借、期货交易保证金、应收利息、应收申购款等流动性资产的比例合计不得低于10%，剩余期限在10个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过30%；剩余期限在1个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资的比例，不得超过基金资产净值的50%。 （2）投资组合平均剩余存续期与平均剩余存续期的计算公式 投资组合平均剩余存续期＝∑投资组合现金资产净值×剩余存续期／投资组合资产净值。现金资产，国债、中央银行票据、政策性金融债券、银行定期存款、同业存单、大额存单、债券、逆回购、银行间拆借、期货交易保证金、应收利息、应收申购款等流动性受限资产的比例合计不得低于10%，剩余期限在10个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得低于30%；基金管理人对本基金前10名份额持有人的持有份额比例进行跟踪时，可不将其固有资金投资的基金份额纳入跟踪范围； （3）投资组合平均剩余期限与平均剩余存续期的计算公式 投资组合平均剩余期限＝∑投资组合现金资产净值×剩余期限／投资组合资产净值。现金资产，国债、中央银行票据、政策性金融债券、银行定期存款、同业存单、大额存单、债券、逆回购、银行间拆借、期货交易保证金、应收利息、应收申购款等流动性受限资产的剩余期限均按剩余存续期计算。 （4）投资组合平均剩余期限与平均剩余存续期的计算方法 投资组合平均剩余期限＝∑投资组合现金资产净值×剩余期限／投资组合资产净值。现金资产，国债、中央银行票据、政策性金融债券、银行定期存款、同业存单、大额存单、债券、逆回购、银行间拆借、期货交易保证金、应收利息、应收申购款等流动性受限资产的剩余期限均按剩余存续期计算。	（15）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 （16）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。 （17）本基金管理人管理的全部开放式基金合计持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%，完全按照指数编制方案进行复制的指数型基金除外；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%，但投资于有存款期限、根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制。
十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基金投资组合应符合以下规定：	3. 剩余期限不超过397天的债券投资比例，不得超过基金资产净值的20%； 4. 剩余期限在397天以内（含397天）的债券，其剩余期限不得超过1年； 5. 剩余期限在397天以内（含397天）的债券，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的30%，但投资于有存款期限、根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制； 6. 剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的20%； 7. 剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的10%； 8. 剩余期限在397天以内（含397天）的短期融资券，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的10%； 9. 剩余期限在397天以内（含397天）的其他品种，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的20%； 10. 剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的20%； 11. 剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的10%； 12. 剩余期限在397天以内（含397天）的短期融资券，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的10%； 13. 剩余期限在397天以内（含397天）的其他品种，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的20%； 14. 剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的20%； 15. 剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的10%； 16. 剩余期限在397天以内（含397天）的短期融资券，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的10%； 17. 剩余期限在397天以内（含397天）的其他品种，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的20%； 18. 剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的20%； 19. 剩余期限在397天以内（含397天）的中期票据，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的10%； 20. 剩余期限在397天以内（含397天）的短期融资券，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的10%； 21. 剩余期限在397天以内（含397天）的其他品种，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的20%。	（19）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的百分之五，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 …… （20）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。 …… （21）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基金投资组合应符合以下规定：	（15）除发生日期顺延、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回50%以上的情形外，本基金投资组合中，债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%。 因发生日期顺延或依供货市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%，基金管理人应当在5个交易日内进行调整。 （16）当本基金剩10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%；基金管理人对本基金前10名份额持有人的持有份额比例进行跟踪时，可不将其固有资金投资的基金份额纳入跟踪范围； （17）当本基金剩10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；基金管理人对本基金前10名份额持有人的持有份额比例进行跟踪时，可不将其固有资金投资的基金份额纳入跟踪范围； （18）当本基金剩10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的剩余期限在397天以内（含397天）的债券，其剩余期限在1年以内（含1年）的比例，不得超过基金资产净值的30%，但投资于有存款期限、根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制； （19）本基投资投资于主体信用评级低于AAA的商业银行的银行存款为货币市场类产品，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。 （20）本基投资投资于货币市场基金的比例合计不得超过本基金资产净值的20%。 （21）本基投资投资于开放式基金的比例合计不得超过本基金资产净值的30%。 （22）本基投资投资于主体信用评级低于AAA的商业银行的银行存款为投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在10个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。	（20）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 …… （21）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。 …… （22）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的15%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。 …… （23）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的15%。
十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基投资组合应符合以下规定：	（16）除发生日期顺延、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回50%以上的情形外，本基金投资组合中，债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%。 因发生日期顺延或依供货市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%，基金管理人应当在5个交易日内进行调整。 （17）本基金不得投资于可转换债券； （18）本基投资持有的剩余期限不超过债券的债券成本总计不得超过当日基金资产净值的20%； （19）本基投资持有的剩余期限不超过1年的中央银行票据的债券成本总计不得超过当日基金资产净值的20%。 （20）本基不得投资于可以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外。	（21）本基投资投资于货币市场基金的比例合计不得超过本基金资产净值的20%。 （22）本基投资投资于开放式基金的比例合计不得超过本基金资产净值的30%。 （23）本基投资投资于主体信用评级低于AAA的商业银行的银行存款为投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在10个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。
十三、基金的投资 （八）投资组合限制与禁止行为 1. 本基投资组合应符合以下规定：	（17）本基投资投资于货币市场基金的比例合计不得超过本基金资产净值的20%。 （18）本基投资投资于开放式基金的比例合计不得超过本基金资产净值的30%。 （19）本基投资投资于主体信用评级低于AAA的商业银行的银行存款为投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在10个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。	（24）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的百分之五，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 …… （25）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。 …… （26）本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的15%。
十六、基金财产估值 （四）估值方法	4. 由于投资成本或本估值可能会出现被低估或大额的价格偏离，为消除或减少因基金资产净值的背离导致基金持有人权益的稀释或其他不公平的结果，在实施操作中，基金管理人与基金托管人需对基金资产净值按市价法定期进行重新评估，即进行“断子定价”。当断子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应当使用风险准备金或者国务院财政部规定的其他资金，补足，对于偏离度的绝对值达到或超过0.5%的情形，基金管理人应编制并披露临时报告。	4. 由于投资成本或本估值可能会出现被低估或大额的价格偏离，为消除或减少因基金资产净值的背离导致基金持有人权益的稀释或其他不公平的结果，在实施操作中，基金管理人与基金托管人需对基金资产净值按市价法定期进行重新评估，即进行“断子定价”。当断子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应当使用风险准备金或者国务院财政部规定的其他资金，补足，对于偏离度的绝对值达到或超过0.5%的情形，基金管理人应编制并披露临时报告。
十六、基金财产估值 （四）估值方法	新增： 5. 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；	新增： 5. 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
二十、基金的信息披露 报告 （三）定期	基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金份额净值表现的有关内容。除上述第（1）项、第（6）项第1款、第（7）项、第（8）项及法律法规另有约定外，因基金规模或市场变化等基金管理人之外的原因导致投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在10个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。 （9）本基投资投资于主体信用评级低于AAA的商业银行的银行存款为投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人应在10个交易日内调整完毕，以符合有关限制规定。 （10）本基金不得投资于可以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券。	新增： （2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 …… （3）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值。
二十、基金的信息披露 报告 （三）定期	新增： 6. 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值。	新增： 6. 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值。
二十、基金的信息披露 报告 （四）暂停估值的情形	新增： 7. 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值。	新增： 7. 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值。

工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金修改基金合同、托管协议有关条款的公告

根据有关法律法规要求和《工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，对工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的《基金合同》、《托管协议》有关条款进行修改。现将有关情况说明如下：

一、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规的要求和《基金合同》的约定，对《基金合同》的前言、释义、申购赎回、投资限制、估值和信息披露等章节的相关内容进行了修改，《托管协议》对应部分内容同步修改。同时，对《基金合同》、《托管协议》中的基金管理人和基金托管人的基本信息进行了更新。

《基金合同》和《托管协议》的修改详见附件《工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》。

二、自2018年4月1日（含该日）起，投资者赎回时，对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

三、修改后的《基金合同》、《托管协议》自4月1日起生效。本基金管理人将于公告当日将修改后的《基金合同》、《托管协议》登载于公司网站，并在下期更新的《工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金招募说明书》中对上述相关内容进行相应修改。

投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》及相关法律文件。

投资者可登录本基金管理人网站（www.icbccs.com.cn）或拨打本基金管理人的客户服务电话（400-811-9999）获取相关信息。

本公告的解释权归本公司所有。

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

工银瑞信基金管理有限公司
二〇一八年三月二十四日

附件：《工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》

一、基金合同主要修订内容

章节	修订内容
前言	增加： 《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称《流动性风险规定》）的表述
释义	增加： “《流动性风险规定》：指中国证监会2017年6月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订”。
释义	增加： “流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格实现变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等”。
释义	增加： “摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整份额投组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待”。
基金份额的申购、赎回与转换	“（三）申购与赎回的原则”中，增加： “5. 当本基金发生大额申购或赎回情形时，按照法律法规及监管要求，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。”
基金份额的申购、赎回与转换	“（五）申购与赎回的数额限制”中，增加： “4. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，以保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见相关公告。”
基金份额的申购、赎回与转换	“（七）申购和赎回的费用及其用途”中，增加： “3. 本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，但赎回费用全额计入基金财产。实际执行的赎回费率（赎回费率低于0.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。”
基金份额的申购、赎回与转换	“（九）巨额赎回的认定及处理方式”之“2. 巨额赎回的处理方式”中，增加： “（4）接受某笔或某些申购申请可能导致单一投资者持有基金份额的比例超过50%，或者受到规模80%集中度的情形时； （7）某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的单日净申购比例上限，单一投资者单日或单笔申购金额上限的； （8）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；”
基金份额的申购、赎回与转换	“（十）拒绝或暂停申购的情形及处理”之“2.在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：”中，增加： “（16）接受某笔或某些申购申请可能导致单一投资者持有基金份额的比例超过50%，或者受到规模80%集中度的情形时； （17）某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的单日净申购比例上限，单一投资者单日或单笔申购金额上限的； （18）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；”
基金份额的申购、赎回与转换	每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。 …… 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，法律法规另有规定的从其规定。	每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 …… （16）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 （17）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。 （18）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。
基金管理人与基金托管人的业务监督和核查	“（二）基金托管人”之“1.基金托管人基本情况”中，修改： 法定代表人：陈沉清	
二、基金托管协议修改内容	增加： “（2）投资范围”中增加“……，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等”。 “（4）投资禁止行为与限制”之“2.基金投资组合比例限制”中，增加： “（10）本基金主动投资于流动性受限资产的市值不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。” “（11）本基金投资于开放式证券投资基金流动性风险管理规定”等有关法律法规的规定，对基金投资组合比例符合基金合同的有关约定、因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述（1）-（6）规定比例或基金投资组合比例不符合上述（1）-（6）规定比例或基金投资组合比例不符合上述（1）-（6）规定比例或基金投资不符合上述（1）-（6）规定比例或基金投资组合比例不符合上述（1）-（6）规定比例或基金投资组合比例不符合上述（1）-（6）规定比例或基金投资组合比例